

富国深证 100 交易型开放式指数证券投资基金  
二〇二五年中期报告

2025 年 06 月 30 日

基金管理人：富国基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2025 年 08 月 30 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

富国基金管理有限公司的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 8 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

富国基金管理有限公司承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2025 年 4 月 2 日（基金合同生效日）起至 2025 年 6 月 30 日止。

## 1.2 目录



## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	富国深证 100 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	富国深证 100ETF
场内简称	深证 100ETF 富国
基金主代码	159211
交易代码	159211
基金运作方式	契约型，交易型开放式
基金合同生效日	2025 年 04 月 02 日
基金管理人	富国基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	13,683,294.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2025 年 4 月 14 日

### 2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金采用完全复制法，即按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。在正常市场情况下，本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。本基金的资产配置策略、存托凭证投资策略、债券投资策略、可转换债券（含可分离交易可转债）及可交换债券投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略、国债期货投资策略、股票期权投资策略、参与融资及转融通证券出借业务策略详见法律文件。
业绩比较基准	深证 100 指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股，具有与标的指数相似的风险收益特征。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	富国基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	赵瑛
	联系电话	021-20361818
	电子邮箱	public@fullgoal.com.cn
客户服务电话	95105686、4008880688	95588

传真	021-20361616	010—66105798
注册地址	中国(上海)自由贸易试验区世纪大道 1196 号世纪汇办公楼二座 27-30 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址	上海市浦东新区世纪大道 1196 号世纪汇办公楼二座 27-30 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码	200120	100140
法定代表人	裴长江	廖林

#### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www. fullgoal. com. cn
基金中期报告备置地点	富国基金管理有限公司 上海市浦东新区世纪大道 1196 号世纪汇办公楼二座 27-30 层 中国工商银行股份有限公司 北京市西城区复兴门内大街 55 号

#### 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2025年4月2日(基金合同生效日)至2025年6月30日
本期已实现收益	3,289,923.83
本期利润	4,081,614.39
加权平均基金份额本期利润	0.0625
本期加权平均净值利润率	6.17%
本期基金份额净值增长率	6.66%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2025年06月30日)
期末可供分配利润	911,159.67
期末可供分配基金份额利润	0.0666
期末基金资产净值	14,594,453.67
期末基金份额净值	1.0666
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025年06月30日)
基金份额累计净值增长率	6.66%

注：本基金于2025年4月2日成立，自合同生效日起至本报告期末不足半年。上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，开放式基金的申购赎回费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

### 3.2 基金净值表现

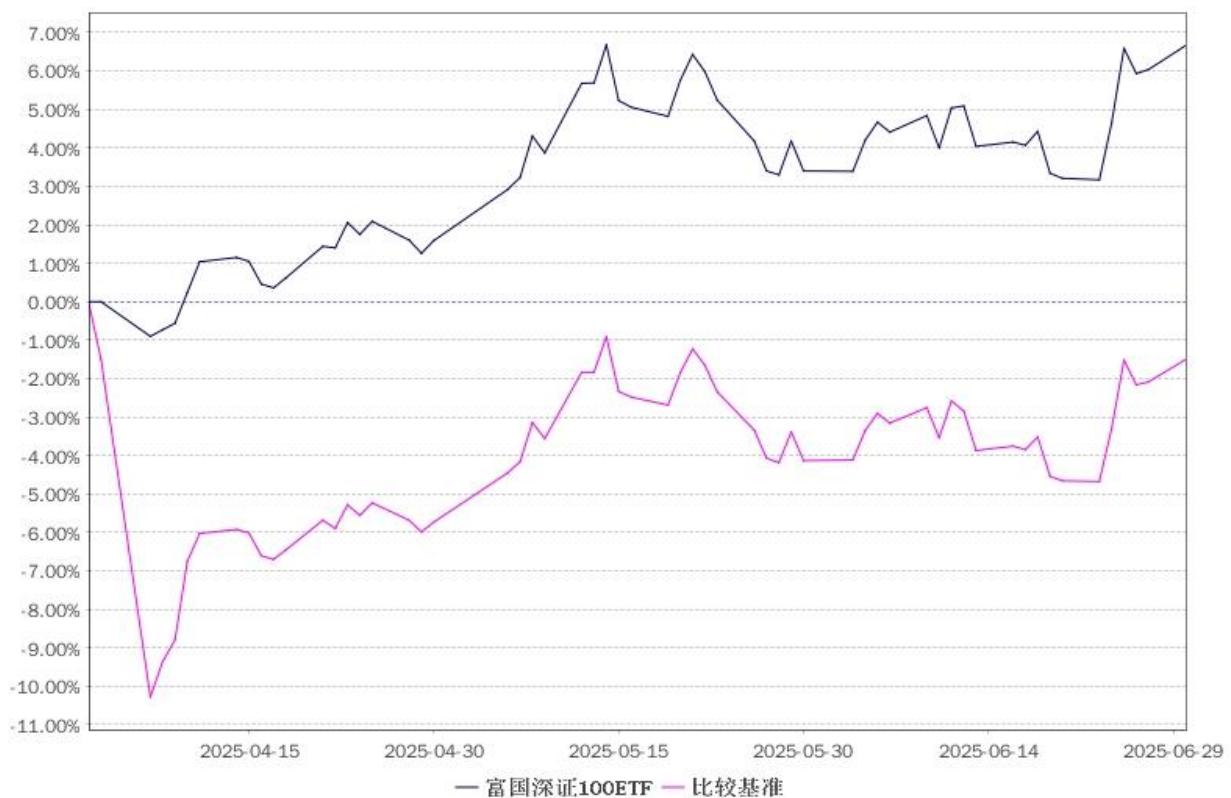
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	3.15%	0.75%	2.74%	0.76%	0.41%	-0.01%
自基金合同生	6.66%	0.70%	-1.50%	1.42%	8.16%	-0.72%

效起至今						
------	--	--	--	--	--	--

注：本基金业绩比较基准根据基金合同中投资策略及资产配置比例等相关规定构建，能够较好地反映本基金的风险收益特征。本基金每个交易日对业绩比较基准依据合同约定的权重比例进行再平衡处理，并用每日连乘方式计算得到指数基准的时间序列。

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、截止日期为 2025 年 6 月 30 日。

2、本基金于 2025 年 4 月 2 日成立，自合同生效日起至本报告期末不足一年。本基金建仓期 6 个月，从 2025 年 4 月 2 日起至 2025 年 10 月 1 日，本期末建仓期还未结束。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

富国基金管理有限公司于1999年4月13日获国家工商行政管理局登记注册成立，是经中国证监会批准设立的首批十家基金管理公司之一。公司于2001年3月从北京迁址上海。2003年9月，加拿大蒙特利尔银行（BMO）参股富国基金管理有限公司的工商变更登记办理完毕，富国基金管理有限公司成为国内首批成立的十家基金公司中，第一家中外合资的基金管理公司。

目前，公司注册资本金5.2亿元人民币，股东为：国泰海通证券股份有限公司、申万宏源证券有限公司、加拿大蒙特利尔银行及山东省金融资产管理股份有限公司。公司在北京、成都、广州设立有分公司，并全资设有两家子公司——富国资产管理（上海）有限公司和富国资产管理（香港）有限公司。公司拥有公募基金、特定客户资产管理、QDII、社保、企业年金、基本养老保险基金等基金公司全部业务牌照。

经中国证监会于2025年1月17日批复核准，国泰君安证券股份有限公司（以下简称“国泰君安”）吸收合并海通证券股份有限公司（以下简称“海通证券”）。自本次吸收合并交割日（即2025年3月14日）起，合并后的国泰君安（以下简称“存续公司”）承继及承接海通证券的全部资产、负债、业务、人员、合同、资质及其他一切权利与义务，海通证券所持本公司股权亦归属于存续公司，即存续公司成为本公司的主要股东。根据2025年4月4日《国泰海通证券股份有限公司关于完成公司名称变更、注册资本变更、公司章程修订及相应市场主体变更登记的公告》，存续公司正式更名为“国泰海通证券股份有限公司”。

截至2025年6月30日，本基金管理人共管理富国天盛灵活配置混合型证券投资基金、富国天惠精选成长混合型证券投资基金（LOF）、富国新兴产业股票型证券投资基金、富国中证智能汽车指数证券投资基金（LOF）、富国中证红利指数增强型证券投资基金、上证综指交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金、富国天利增长债券投资基金、富国目标收益一年期纯债债券型证券投资基金、富国中债-1-3年国开行债券指数证券投资基金、富国全球科技互联网股票型证

券投资基金(QDII)、富国鑫旺稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金(FOF)、富国富钱包货币市场基金、富国首创水务封闭式基础设施证券投资基金等 391 只公开募集证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
殷钦怡	本基金现任基金经理	2025-04-02	—	8	硕士，曾任国泰君安证券股份有限公司资深分析师；自 2023 年 7 月加入富国基金管理有限公司，历任定量研究员；现任富国基金量化投资部定量基金经理。自 2024 年 07 月起任富国中证国企一带一路交易型开放式指数证券投资基金基金经理；自 2024 年 07 月起任富国中证国企一带一路交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理；自 2024 年 07 月起任富国中证全指建筑材料交易型开放式指数证券投资基金基金经理；自 2024 年 07 月起任富国中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金基金经理；自 2024 年 07 月起任富国中证细分化工产业主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理；自 2024 年 07 月起任富国中证细分化工产业主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理；自 2025 年 02 月起任富国中证 800 银行交易型开放式指数证券投资基金基金经理；自 2025 年 02 月起任富国中证细分机械设备产业主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理；自 2025 年 02 月起任富国中证新华社民族品牌工程交易型开放式指数证券投资基金基金经理；自 2025 年 02 月起任富国中证新华社民族品牌工程交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理；自 2025 年 04 月起任富国国证通用航空产业交易型开放式指数证券投资基金基金经理；自 2025 年 04 月起任富国深

					证 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理；自 2025 年 06 月起任富国上证科创板人工智能交易型开放式指数证券投资基金基金经理；具有基金从业资格。
--	--	--	--	--	---

注：1、上述任职日期为根据公司决定确定的聘任日期，离任日期为根据公司确定的解聘日期；首任基金经理任职日期为基金合同生效日。2、证券从业的涵义遵从中国证监会《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期，富国基金管理有限公司作为富国深证 100 交易型开放式指数证券投资基金的管理人严格按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《中华人民共和国证券法》、《富国深证 100 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》以及其它有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，以尽可能减少和分散投资风险、力保基金资产的安全并谋求基金资产长期稳定收益为目标，基金投资组合符合有关法规及基金合同的规定。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和相关法规要求，制定了《证券投资公平交易管理办法》，保证公司旗下不同投资组合在系统控制、日常操作层面享有公平的交易机会，并保持各投资组合的独立投资决策权。

本报告期内公司旗下基金严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，在投资管理活动中公平对待不同投资组合，未出现违反公平交易制度的情况。

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现异常交易行为。

在交易所公开竞价同日反向交易的控制方面，报告期内本基金与公司管理的其他投资组合之间未出现成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5%的情况。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2025年初，外部关税担忧给全球风险资产带来扰动，市场迎来快速调整。春节后，国内大模型的出现，缩小了市场对于中美AI发展前景的认知差异，市场以AI为核心开启了新一轮上行，内外资共振流入重估中国资产。随着两会积极的政策定调、以及一系列更加聚焦需求侧、民生侧的政策密集落地，市场由前期AI板块的“一枝独秀”，逐步扩散至消费、金融、周期等低位顺周期板块。4月初，由于美国对全球加征不合理关税，中国随后进行反制，中美关税摩擦逐步升级，中美进入“不可贸易”状态。美国滥施关税给全球资本市场带来大规模冲击。4月8日，中央汇金发布公告，通过增持ETF进入市场，同时中央部门、地方政府与上市公司合力维护市场稳定，指数稳步上行。国内方面，5月7日国内推出一揽子金融支持政策，包含全面降准降息、维护股市楼市。海外方面，中美在关税问题上达成共识，缓解贸易摩擦该阶段市场普涨。5月中旬起，由于海外关税存在反复，美债及日债拍卖利率跳升，对全球市场流动性存在扰动，同时伊朗与以色列冲突加剧全球避险情绪，市场整体振幅加大。6月下旬，随着伊朗与以色列阶段性停火，鲍威尔表态偏鸽、美联储7月降息的可能性提升，市场开始反弹。

总体来看，2025年上半年上证综指上涨2.76%，沪深300上涨0.03%，创业板指上涨0.53%，中证500指数上涨3.31%。

在投资管理上，本基金采用量化和人工管理相结合的方法，处理基金日常运作中的大额申购和赎回等事件，合理安排仓位及头寸，将跟踪误差控制在合理水平，努力为投资者提供更合格的投资工具。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2025年6月30日，本基金份额净值为1.0666元；份额累计净值为1.0666元；本报告期，本基金份额净值增长率为6.66%；同期业绩比较基准收益率为-1.50%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，市场逐步向好的条件在持续累积。随着稳定资本市场政策逐步深入人心，市场对于阶段性宏观数据扰动有所免疫，风险偏好有望提升。伴随着

反内卷政策的出台，市场对于短期可能存在的需求回落担忧也有望缓解，着眼未来，在减少资本开支的大背景下，上游周期和中游制造产能过剩情况均有望持续好转，企业盈利有望逐步改善。与此同时，在中美谈判持续推进和国内外 AI 模型持续发展的背景下，科技也有望进一步打开估值空间。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》等法律法规、估值指引的相关规定，以及基金合同对估值程序的相关约定，对基金所持有的投资品种进行估值。日常估值的账务处理、基金份额净值的计算由基金管理人独立完成，并与基金托管人进行账务核对，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规、本基金《基金合同》的约定以及基金的实际运作情况，本报告期内本基金未进行收益分配。本基金将严格按照法律法规及基金合同约定进行收益分配。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

1、本报告期内本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情形。

2、自 2025 年 4 月 28 日至 2025 年 6 月 30 日，本基金存在资产净值连续二十个工作日低于五千万元的情况。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本基金的管理人——富国基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对富国基金管理有限公司编制和披露的本基金 2025 年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## § 6 中期财务报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：富国深证 100 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2025 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资产	本期末 2025 年 06 月 30 日
<b>资产：</b>	
货币资金	100,486.73
结算备付金	—
存出保证金	—
交易性金融资产	14,463,398.38
其中：股票投资	14,463,398.38
基金投资	—
债券投资	—
资产支持证券投资	—
贵金属投资	—
其他投资	—
衍生金融资产	—
买入返售金融资产	—
应收清算款	238.59
应收股利	—
应收申购款	—
递延所得税资产	—
其他资产	75,547.80
资产总计	14,639,671.50
<b>负债和净资产</b>	<b>本期末 2025 年 06 月 30 日</b>
<b>负债：</b>	
短期借款	—
交易性金融负债	—
衍生金融负债	—
卖出回购金融资产款	—
应付清算款	—
应付赎回款	—
应付管理人报酬	2,051.80
应付托管费	683.93
应付销售服务费	—
应付投资顾问费	—
应交税费	—

应付利润	—
递延所得税负债	—
其他负债	42,482.10
负债合计	45,217.83
<b>净资产：</b>	
实收基金	13,683,294.00
其他综合收益	—
未分配利润	911,159.67
净资产合计	14,594,453.67
负债和净资产总计	14,639,671.50

注：报告截止日 2025 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.0666 元，基金份额总额 13,683,294.00 份。本基金合同生效日 2025 年 04 月 02 日。

## 6.2 利润表

会计主体：富国深证 100 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2025 年 04 月 02 日至 2025 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 4 月 2 日(基金合同生效 日)至 2025 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>	4,192,563.85
1. 利息收入	16,191.79
其中：存款利息收入	16,191.79
债券利息收入	—
资产支持证券利息收入	—
买入返售金融资产收入	—
其他利息收入	—
2. 投资收益（损失以“-”填列）	3,384,681.50
其中：股票投资收益	2,990,966.56
基金投资收益	—
债券投资收益	—
资产支持证券投资收益	—
贵金属投资收益	—
衍生工具收益	—
股利收益	393,714.94
以摊余成本计量的金融资产终止 确认产生的收益	—
其他投资收益	—
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填	791,690.56

列)	
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	—
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	—
<b>减：二、营业总支出</b>	110,949.46
1. 管理人报酬	23,321.34
2. 托管费	7,773.82
3. 销售服务费	—
4. 投资顾问费	—
5. 利息支出	—
其中：卖出回购金融资产支出	—
6. 信用减值损失	—
7. 税金及附加	—
8. 其他费用	79,854.30
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	4,081,614.39
<b>减：所得税费用</b>	—
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	4,081,614.39
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>	—
<b>六、综合收益总额</b>	4,081,614.39

注：本基金合同生效日为 2025 年 4 月 2 日，无上年度同期对比数据。

### 6.3 净资产变动表

会计主体：富国深证 100 交易型开放式指数证券投资基金管理

本报告期： 2025 年 04 月 02 日至 2025 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 4 月 2 日(基金合同生效日)至 2025 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、本期期初净资产	237,683,294.00	—	237,683,294.00
二、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-224,000,000.00	911,159.67	-223,088,840.33
(一)、综合收益总额	—	4,081,614.39	4,081,614.39
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-224,000,000.00	-3,170,454.72	-227,170,454.72
其中：1. 基金申购款	—	—	—
2. 基金赎回款	-224,000,000.00	-3,170,454.72	-227,170,454.72
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”	—	—	—

号填列)			
(四)、其他综合收益结转留存收益	—	—	—
四、本期期末净资产	13,683,294.00	911,159.67	14,594,453.67

注：本基金合同生效日为 2025 年 4 月 2 日，无上年度同期对比数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

陈戈

林志松

徐慧

基金管理公司负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

富国深证 100 交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可〔2024〕1879 号《关于准予富国深证 100 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》的核准，由基金管理人富国基金管理有限公司自 2025 年 3 月 17 日至 2025 年 3 月 28 日止期间向社会公开发行募集，募集期结束经德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具德师报(验)字(25)第 00094 号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于 2025 年 4 月 2 日正式生效。本基金为契约型，交易型开放式，存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币 237,675,000.00 元，折合 237,675,000.00 份基金份额；有效认购资金在首次募集期间产生的利息为人民币 9,550.85 元，折合基金份额 8,294.00 份，剩余人民币 1,256.85 元不折算为投资者基金份额直接计入基金财产。与首次募集相关的资产总额为人民币 237,684,550.85 元，折合 237,683,294.00 份基金份额。本基金的基金管理人为富国基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金的投资范围主要为标的指数成份股和备选成份股（均含存托凭证）。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于部分非成份股（包含主板、科创板、创业板及其他经中国证监会允许发行的股票）、存托凭证、债券（国债、央行票据、地方政府债券、政府支持机构债券、政府支持债券、金融债券、企业债券、公司债券、次级债券、可转换债券、可交换债券、可分离交易可转债、短期融资

券（含超短期融资券）、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、衍生工具（股指期货、国债期货、股票期权等）、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金可根据法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：本基金投资于标的指数成份股和备选成份股（均含存托凭证）的比例不得低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%，因法律法规的规定而受限制的情形除外。如法律法规对该比例要求有变更的，在履行适当程序后，以变更后的比例为准，本基金的投资比例会做相应调整。

本基金的业绩比较基准为：深证 100 指数收益率。

#### **6.4.2 会计报表的编制基础**

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金管理信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号《年度报告和中期报告》》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### **6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明**

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2025 年 6 月 30 日的财务状况以及 2025 年 4 月 2 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

## **6.4.4 重要会计政策和会计估计**

### **6.4.4.1 会计年度**

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间系 2025 年 4 月 2 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日止。

### **6.4.4.2 记账本位币**

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

### **6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类**

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

#### **(1) 金融资产分类**

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

#### **(2) 金融负债分类**

本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

### **6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认**

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确

认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益；

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况；

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息；

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产；

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资

产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（含交易性金融负债和衍生金融负债），按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用

的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

- (2) 不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；
- (3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；
- (4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### **6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销**

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### **6.4.4.7 实收基金**

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### **6.4.4.8 损益平准金**

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净资产比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全

额转入“未分配利润/(累计亏损)”。

#### 6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或内含票面利率或合同利率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；

处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(3) 股利收益于除息日确认，并按发行人宣告的分红派息比例计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账；

(4) 处置衍生工具的投资收益于成交日确认，并按处置衍生工具成交金额与其成本的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(5) 买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；

(6) 公允价值变动收益系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(7) 转融通证券出借业务利息收入按出借起始日证券账面价值及出借费率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额，在转融通证券实际出借期间内逐日计提。因借入人未能按期归还产生的罚息，实际发生时扣除适用情况下的相关税费后的净额计入转融通证券出借业务利息收入。出借证券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入计入投资收益；

(8) 其他收入在本基金履行了基金合同中的履约义务，即在客户取得服务控制权时确认收入。

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

- 1、每一基金份额享有同等分配权；
- 2、基金管理人可每季度进行评估及收益分配，在符合基金收益分配条件下，可安排收益分配。评估时间、分配时间、分配方案及每次基金收益分配数额等内容，基金管理人可以根据实际情况确定并按照有关规定公告；
- 3、每次基金收益分配数额的确定原则为使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补亏损为前提，收益分配后有可能使基金份额净值低于面值，即基金收益分配基准日（即收益评价日）的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后可能低于面值；
- 4、若基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配；
- 5、本基金收益分配采用现金方式；
- 6、法律法规、监管机关、登记机构、深圳证券交易所另有规定的，从其规定。

在遵守法律法规和监管部门的规定，且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金管理人在履行适当程序后可对基金收益分配原则和支付方式进行调整，不需召开基金份额持有人大会，并应于变更实施日前在规定媒介公告。

#### 6.4.4.12 分部报告

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

- (1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；
- (2) 能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；
- (3) 能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。

如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

#### **6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计**

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

#### **6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

##### **6.4.5.1 会计政策变更的说明**

本基金本报告期无会计政策变更。

##### **6.4.5.2 会计估计变更的说明**

本基金本报告期无会计估计变更。

##### **6.4.5.3 差错更正的说明**

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### **6.4.6 税项**

##### **1 印花税**

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰ 调整为 1‰；根据财政部、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

##### **2 增值税**

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金管理过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对证券投资基金在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。增值税应税行为的销售额根据财政部、国家税务总局财税[2017]90号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定确定。

### 3 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税法》、《征收教育费附加的暂行规定（2011年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育附加。

### 4 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号文《关于证券投资基金管理政策的通知》的规定，自2004年1月1日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、

债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

## 5 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自2008年10月9日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自2013年1月1日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在1个月以内（含1个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年（含1年）的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂减按25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自2015年9月8日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过1年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 (2025年06月30日)
活期存款	83,001.89
等于：本金	82,993.97
加：应计利息	7.92
减：坏账准备	—
定期存款	—
等于：本金	—
加：应计利息	—
减：坏账准备	—
其中：存款期限1个月以内	—
存款期限1-3个月	—
存款期限3个月以上	—

其他存款		17,484.84
等于：本金		17,482.74
加：应计利息		2.10
减：坏账准备		—
合计		100,486.73

注：本基金本报告期末未持有定期存款。其他存款本期末余额为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末（2025年06月30日）			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	13,671,707.82	—	14,463,398.38	791,690.56
贵金属投资-金交所黄金合约	—	—	—	—
债券	—	—	—	—
交易所市场	—	—	—	—
银行间市场	—	—	—	—
合计	—	—	—	—
资产支持证券	—	—	—	—
基金	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	13,671,707.82	—	14,463,398.38	791,690.56

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本报告期末本基金未持有衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末无买断式逆回购交易。

#### 6.4.7.5 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末（2025年06月30日）
应收利息	—

其他应收款	—
待摊费用	75,547.80
合计	75,547.80

#### 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末（2025年06月30日）
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	—
应付证券出借违约金	—
应付交易费用	—
其中：交易所市场	—
银行间市场	—
应付利息	—
预提信息披露费	30,000.00
预提审计费	12,482.10
合计	42,482.10

#### 6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2025 年 4 月 2 日(基金合同生效日)至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日 2025 年 4 月 2 日	237,683,294.00	237,683,294.00
本期申购	—	—
本期赎回(以“-”号填列)	-224,000,000.00	-224,000,000.00
本期末	13,683,294.00	13,683,294.00

#### 6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日 2025 年 4 月 2 日	—	—	—
本期利润	3,289,923.83	791,690.56	4,081,614.39
本期基金份额交易产生的变动数	-2,222,617.33	-947,837.39	-3,170,454.72
其中：基金申购款	—	—	—
基金赎回款	-2,222,617.33	-947,837.39	-3,170,454.72
本期已分配利润	—	—	—
本期末	1,067,306.50	-156,146.83	911,159.67

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 4 月 2 日(基金合同生效日)至 2025 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	3,705.32
定期存款利息收入	—
其他存款利息收入	12,486.47
结算备付金利息收入	—
其他	—
合计	16,191.79

#### 6.4.7.10 股票投资收益

##### 6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 4 月 2 日(基金合同生效日)至 2025 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-10,026.14
股票投资收益——赎回差价收入	3,000,992.70
股票投资收益——申购差价收入	—
合计	2,990,966.56

##### 6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 4 月 2 日(基金合同生效日)至 2025 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	6,882,566.78
减： 卖出股票成本总额	6,838,842.06
减： 交易费用	53,750.86
买卖股票差价收入	-10,026.14

##### 6.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 4 月 2 日(基金合同生效日)至 2025 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	227,170,454.72
减： 现金支付赎回款总额	12,557.72
减： 赎回股票成本总额	224,156,904.30
减： 交易费用	—
赎回差价收入	3,000,992.70

#### **6.4.7.10.4 股票投资收益——申购差价收入**

注：本基金本报告期无股票投资收益——申购差价收入。

#### **6.4.7.11 债券投资收益**

##### **6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成**

注：本基金本报告期无债券投资收益。

##### **6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入**

注：本基金本报告期无买卖债券差价收入。

#### **6.4.7.12 资产支持证券投资收益**

##### **6.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成**

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

##### **6.4.7.12.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入**

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入。

#### **6.4.7.13 贵金属投资收益**

注：本基金本报告期无买卖贵金属交易。

#### **6.4.7.14 衍生工具收益**

##### **6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

注：本基金本报告期无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

##### **6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益**

注：本基金本报告期无衍生工具收益——其他投资收益。

#### **6.4.7.15 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 4 月 2 日(基金合同生效日)至 2025 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	393,714.94
其中：证券出借权益补偿收入	—
基金投资产生的股利收益	—
合计	393,714.94

#### 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025 年 4 月 2 日(基金合同生效日)至 2025 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	791,690.56
股票投资	791,690.56
债券投资	—
资产支持证券投资	—
基金投资	—
贵金属投资	—
其他	—
2. 衍生工具	—
权证投资	—
3. 其他	—
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	—
合计	791,690.56

#### 6.4.7.17 其他收入

注：本基金本报告期无其他收入。

#### 6.4.7.18 信用减值损失

注：本基金本报告期无信用减值损失。

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 4 月 2 日(基金合同生效日)至 2025 年 6 月 30 日
审计费用	12,482.10
信息披露费	30,000.00
证券出借违约金	—
银行费用	20.00
其他	37,352.20
合计	79,854.30

### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

### **6.4.8.2 资产负债表日后事项**

截至财务报表批准日，本基金无其他需要披露的资产负债表日后事项。

### **6.4.9 关联方关系**

#### **6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况**

本基金本报告期存在控制关系或其他重大影响关系的关联方未发生变化。

#### **6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方**

关联方名称	与本基金的关系
富国基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
国泰海通证券股份有限公司（“国泰海通”）	基金管理人的股东、基金代销机构
申万宏源证券有限公司（“申万宏源”）	基金管理人的股东、基金代销机构
中国工商银行股份有限公司（“工商银行”）	基金托管人
富国深证 100 交易型开放式指数证券投资 基金联接基金	本基金的联接基金

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

### **6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易**

#### **6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易**

##### **6.4.10.1.1 股票交易**

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行股票交易。本基金合同生效日为 2025 年 04 月 02 日，无上年度同期对比数据。

##### **6.4.10.1.2 权证交易**

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。本基金合同生效日为 2025 年 04 月 02 日，无上年度同期对比数据。

##### **6.4.10.1.3 债券交易**

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券交易。本基金合同生效日为 2025 年 04 月 02 日，无上年度同期对比数据。

#### 6.4.10.1.4 债券回购交易

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行回购交易。本基金合同生效日为2025年04月02日，无上年度同期对比数据。

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期无应支付关联方的佣金。本基金合同生效日为2025年04月02日，无上年度同期对比数据。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 4 月 2 日(基金合同生效日)至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	23,321.34
其中：应支付销售机构的客户维护费	10,332.69
应支付基金管理人的净管理费	12,988.65

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.15%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。

本基金合同生效日为2025年04月02日，无上年度同期对比数据。

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 4 月 2 日(基金合同生效日)至 2025

	年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	7,773.82

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.05% 年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.05\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。

本基金合同生效日为 2025 年 4 月 2 日，无上年度同期对比数据。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

注：本基金本报告期末与关联方通过银行间同业市场进行债券（含回购）交易。

本基金合同生效日 2025 年 04 月 02 日，无上年度同期对比数据。

#### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

##### 6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

注：本基金本报告期末与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率从事证券出借业务。

##### 6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

注：本基金本报告期末与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率从事证券出借业务。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本报告期内本基金的基金管理人未运用固有资金投资本基金。本基金合同生效日为 2025 年 4 月 2 日，无上年度同期对比数据。

#### 6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本基金除基金管理人之外的其他关联方本报告期末未投资本基金。本基金合同生效日为 2025 年 04 月 02 日，无上年度末对比数据。

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 4 月 2 日(基金合同生效日)至 2025 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	83,001.89	3,705.32

注：本基金合同生效日为 2025 年 04 月 02 日，无上年度同期对比数据。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期内未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

##### 6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

为更紧密地跟踪标的指数，降低跟踪误差，经与基金托管人协商一致，本基金在报告期内根据基金合同约定的投资策略投资于基金管理人股东的母公司发

行的股票申万宏源（000166.SZ）。

本报告期末，本基金持有申万宏源 18,400 股，占基金资产净值比例 0.63%。本基金合同生效日 2025 年 04 月 02 日，无上年度同期对比数据。

#### 6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期未进行利润分配。

### 6.4.12 期末（2025 年 06 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

#### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1.1 受限证券类别：股票

金额单位：人民币元

证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
001390	古麒绒材	2025-05-21	6 个月	新股限售	12.08	18.12	23	277.84	416.76	—

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：截至本报告期末 2025 年 06 月 30 日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2025 年 06 月 30 日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末未持有参与转融通证券出借业务的证券。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当

的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。本基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、风险管理部和合规稽核部、相关职能部门和业务部门构成的四级风险管理架构体系。

#### **6. 4. 13. 2 信用风险**

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家上市公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%，但标的指数成分券不受此限。本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。由于国债、央行票据和政策性金融债的信用风险很低，故不进行列示。

##### **6. 4. 13. 2. 1 按短期信用评级列示的债券投资**

注：本表主要列示短期融资券和超短期融资券，债券评级取自第三方评级机构的债项评级，未评级债券列示超短期融资券。本基金本报告期末未持有按短期信用评级列示的信用债。

##### **6. 4. 13. 2. 2 按长期信用评级列示的债券投资**

注：本基金本报告期末未持有按长期信用评级列示的信用债。本表主要列示除短融和超短融之外的信用债，债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

##### **6. 4. 13. 2. 3 按长期信用评级列示的资产支持证券投资**

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。此表中资产支持证券的债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

#### **6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的同业存单投资**

注：本基金本报告期末未持有同业存单。本表主要列示同业存单，评级取自第三方评级机构的主体评级。

#### **6.4.13.3 流动性风险**

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

##### **6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析**

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。

本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除在 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计未超过基金资产净值的 15%。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

本基金本报告期末无重大流动性风险。

## **6.4.13.4 市场风险**

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

### **6.4.13.4.1 利率风险**

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为货币资金、结算备付金、存出保证金及债券投资等。

#### **6.4.13.4.1.1 利率风险敞口**

下表统计了本基金的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

单位：人民币元

本期末（2025年06月30日）	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	100,486.73	—	—	—	—	—	100,486.73
交易性金融资产	—	—	—	—	—	14,463,398.38	14,463,398.38
应收清算款	—	—	—	—	—	238.59	238.59
其他资产	—	—	—	—	—	75,547.80	75,547.80
资产总计	100,486.73	—	—	—	—	14,539,184.77	14,639,671.50
负债							
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	2,051.80	2,051.80
应付托管费	—	—	—	—	—	683.93	683.93
其他负债	—	—	—	—	—	42,482.10	42,482.10
负债总计	—	—	—	—	—	45,217.83	45,217.83
利率敏感度缺口	100,486.73	—	—	—	—	14,493,966.94	14,594,453.67

#### **6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析**

本基金本期末未持有债券资产（不含可转债），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。本基金合同生效日为2025年04月02日，无上年度同期对比数据。

#### **6.4.13.4.2 外汇风险**

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

#### **6.4.13.4.3 其他价格风险**

本基金其他价格风险主要系市场价格风险，市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的证券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

#### **6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口**

本基金的投资范围主要为标的指数成份股和备选成份股（均含存托凭证）。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于部分非成份股（包含主板、科创板、创业板及其他经中国证监会允许发行的股票）、存托凭证、债券（国债、央行票据、地方政府债券、政府支持机构债券、政府支持债券、金融债券、企业债券、公司债券、次级债券、可转换债券、可交换债券、可分离交易可转债、短期融资券（含超短期融资券）、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、衍生工具（股指期货、国债期货、股票期权等）、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金可根据法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。

基金的投资组合比例为：本基金投资于标的指数成份股和备选成份股（均含存托凭证）的比例不得低于基金资产净值的90%，且不低于非现金基金资产的80%，因法律法规的规定而受限制的情形除外。如法律法规对该比例要求有变更的，在履行适当程序后，以变更后的比例为准，本基金的投资比例会做相应调整。

本基金面临的整体市场价格风险列示如下：

金额单位：人民币元

项目	本期末 (2025年06月30日)	
	公允价值	占基金资产净值比例(%)
交易性金融资产—股票投资	14,463,398.38	99.10
交易性金融资产—基金投资	—	—
交易性金融资产—债券投资	—	—
交易性金融资产—贵金属投资	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—
其他	—	—
合计	14,463,398.38	99.10

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

本基金管理人运用资产-资本定价模型(CAPM)对本基金的市场价格风险进行分析。下表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，业绩比较基准所对应的市场组合的价格发生合理、可能的变动时，将对基金净值产生的影响。基金合同生效日为2025年04月02日。

假设	1. 基金的市场价格风险主要源于市场的系统性风险，即与基金的贝塔系数紧密相关；2. 以下分析，除业绩比较基准发生变动，其他影响基金资产公允价值的风险变量保持不变。	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位：人民币元 )
		本期末 (2025年06月30日)
分析	1. 业绩比较基准增加 1%	47,856.97
	2. 业绩比较基准减少 1%	-47,856.97

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的

---

输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

#### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

##### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果 所属的层次	本期末 (2025年06月30日)
第一层次	14,462,981.62
第二层次	—
第三层次	416.76
合计	14,463,398.38

##### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。对于公开市场交易的股票、债券等投资，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

---

#### **6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项**

##### **6. 4. 15. 1 承诺事项**

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

##### **6. 4. 15. 2 其他事项**

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

---

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	14,463,398.38	98.80
	其中：股票	14,463,398.38	98.80
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	资产支持证券	—	—
4	贵金属投资	—	—
5	金融衍生品投资	—	—
6	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
7	银行存款和结算备付金合计	100,486.73	0.69
8	其他各项资产	75,786.39	0.52
9	合计	14,639,671.50	100.00

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

##### 7.2.1.1 指数投资按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	443,563.00	3.04
B	采矿业	108,452.00	0.74
C	制造业	10,974,638.30	75.20
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	63,620.00	0.44
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	68,612.00	0.47
G	交通运输、仓储和邮政业	305,330.00	2.09
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	409,152.00	2.80
J	金融业	1,522,341.32	10.43
K	房地产业	164,471.00	1.13
L	租赁和商务服务业	164,980.00	1.13

M	科学研究和技术服务业	115,518.00	0.79
N	水利、环境和公共设施管理业	—	—
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	122,304.00	0.84
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	—	—
	合计	14,462,981.62	99.10

#### 7.2.1.2 积极投资按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	—	—
C	制造业	416.76	0.00
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	—	—
G	交通运输、仓储和邮政业	—	—
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	—	—
J	金融业	—	—
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	—	—
M	科学研究和技术服务业	—	—
N	水利、环境和公共设施管理业	—	—
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	—	—
	合计	416.76	0.00

#### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	300750	宁德时代	5,800	1,462,876.00	10.02
2	000333	美的集团	11,100	801,420.00	5.49
3	300059	东方财富	28,100	649,953.00	4.45
4	002594	比亚迪	1,900	630,629.00	4.32

5	000858	五 粮 液	4, 100	487, 490. 00		3. 34
6	000651	格力电器	9, 800	440, 216. 00		3. 02
7	002475	立讯精密	10, 400	360, 776. 00		2. 47
8	000725	京东方A	74, 300	296, 457. 00		2. 03
9	300124	汇川技术	4, 400	284, 108. 00		1. 95
10	300308	中际旭创	1, 900	277, 134. 00		1. 90
11	300760	迈瑞医疗	1, 200	269, 700. 00		1. 85
12	002371	北方华创	600	265, 326. 00		1. 82
13	300502	新易盛	1, 920	243, 878. 40		1. 67
14	002352	顺丰控股	5, 000	243, 800. 00		1. 67
15	002714	牧原股份	5, 700	239, 457. 00		1. 64
16	002415	海康威视	8, 400	232, 932. 00		1. 60
17	000063	中兴通讯	7, 100	230, 679. 00		1. 58
18	000001	平安银行	19, 000	229, 330. 00		1. 57
19	300274	阳光电源	3, 300	223, 641. 00		1. 53
20	002142	宁波银行	7, 700	210, 672. 00		1. 44
21	002230	科大讯飞	4, 400	210, 672. 00		1. 44
22	300498	温氏股份	11, 950	204, 106. 00		1. 40
23	000568	泸州老窖	1, 700	192, 780. 00		1. 32
24	000100	TCL 科技	40, 800	176, 664. 00		1. 21
25	000338	潍柴动力	11, 400	175, 332. 00		1. 20
26	002027	分众传媒	22, 600	164, 980. 00		1. 13
27	000425	徐工机械	18, 600	144, 522. 00		0. 99
28	000792	盐湖股份	8, 000	136, 640. 00		0. 94
29	300014	亿纬锂能	2, 900	132, 849. 00		0. 91
30	002463	沪电股份	3, 100	131, 998. 00		0. 90
31	002241	歌尔股份	5, 500	128, 260. 00		0. 88
32	000625	长安汽车	9, 800	125, 048. 00		0. 86
33	002050	三花智控	4, 700	123, 986. 00		0. 85
34	300015	爱尔眼科	9, 800	122, 304. 00		0. 84
35	000977	浪潮信息	2, 400	122, 112. 00		0. 84
36	300033	同花顺	432	117, 940. 32		0. 81
37	000776	广发证券	6, 400	107, 584. 00		0. 74
38	002179	中航光电	2, 500	100, 900. 00		0. 69
39	002311	海大集团	1, 700	99, 603. 00		0. 68
40	002049	紫光国微	1, 500	98, 790. 00		0. 68
41	000938	紫光股份	4, 100	98, 359. 00		0. 67
42	300433	蓝思科技	4, 400	98, 120. 00		0. 67
43	000002	万 科A	15, 100	96, 942. 00		0. 66
44	002028	思源电气	1, 300	94, 783. 00		0. 65
45	300408	三环集团	2, 800	93, 520. 00		0. 64

46	002422	科伦药业	2,600	93,392.00	0.64
47	000166	申万宏源	18,400	92,368.00	0.63
48	000538	云南白药	1,600	89,264.00	0.61
49	002460	赣锋锂业	2,500	84,425.00	0.58
50	002304	洋河股份	1,300	83,915.00	0.57
51	300394	天孚通信	1,020	81,436.80	0.56
52	000157	中联重科	11,000	79,530.00	0.54
53	000768	中航西飞	2,900	79,286.00	0.54
54	002252	上海莱士	11,000	75,570.00	0.52
55	002001	新和成	3,500	74,445.00	0.51
56	002466	天齐锂业	2,300	73,692.00	0.50
57	000975	山金国际	3,800	71,972.00	0.49
58	002736	国信证券	6,200	71,424.00	0.49
59	300896	爱美客	400	69,924.00	0.48
60	000661	长春高新	700	69,426.00	0.48
61	000963	华东医药	1,700	68,612.00	0.47
62	300661	圣邦股份	940	68,403.80	0.47
63	002236	大华股份	4,300	68,284.00	0.47
64	002648	卫星化学	3,900	67,587.00	0.46
65	001979	招商蛇口	7,700	67,529.00	0.46
66	300347	泰格医药	1,200	63,984.00	0.44
67	300418	昆仑万维	1,900	63,897.00	0.44
68	002920	德赛西威	600	61,278.00	0.42
69	002916	深南电路	550	59,295.50	0.41
70	003816	中国广核	15,700	57,148.00	0.39
71	300782	卓胜微	800	57,096.00	0.39
72	002601	龙佰集团	3,500	56,735.00	0.39
73	000895	双汇发展	2,300	56,143.00	0.38
74	002600	领益智造	6,400	54,976.00	0.38
75	300442	润泽科技	1,100	54,483.00	0.37
76	000596	古井贡酒	400	53,260.00	0.36
77	002493	荣盛石化	6,400	52,992.00	0.36
78	000786	北新建材	2,000	52,960.00	0.36
79	302132	中航成飞	600	52,764.00	0.36
80	001965	招商公路	4,300	51,600.00	0.35
81	300759	康龙化成	2,100	51,534.00	0.35
82	301269	华大九天	400	49,552.00	0.34
83	300122	智飞生物	2,500	48,975.00	0.34
84	002938	鹏鼎控股	1,500	48,045.00	0.33
85	000999	华润三九	1,460	45,668.80	0.31
86	300832	新产业	800	45,376.00	0.31

87	000876	新希望	4,800	45,024.00		0.31
88	000301	东方盛虹	5,200	43,316.00		0.30
89	000617	中油资本	5,900	43,070.00		0.30
90	002459	晶澳科技	4,000	39,920.00		0.27
91	300316	晶盛机电	1,400	38,010.00		0.26
92	000983	山西焦煤	5,700	36,480.00		0.25
93	300999	金龙鱼	1,200	35,436.00		0.24
94	300628	亿联网络	1,000	34,760.00		0.24
95	300413	芒果超媒	1,400	30,548.00		0.21
96	000708	中信特钢	1,900	22,344.00		0.15
97	300979	华利集团	300	15,771.00		0.11
98	000877	天山股份	3,100	14,384.00		0.10
99	001872	招商港口	500	9,930.00		0.07
100	001289	龙源电力	400	6,472.00		0.04
101	001390	古麒绒材	23	416.76		0.00

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	300750	宁德时代	21,947,614.00	150.38
2	000333	美的集团	13,517,558.00	92.62
3	002594	比亚迪	12,038,531.00	82.49
4	300059	东方财富	10,103,777.44	69.23
5	000858	五粮液	9,401,711.00	64.42
6	000651	格力电器	7,580,195.00	51.94
7	002475	立讯精密	5,661,108.20	38.79
8	002371	北方华创	5,359,208.00	36.72
9	300760	迈瑞医疗	5,095,050.00	34.91
10	000725	京东方A	4,973,073.00	34.08
11	300124	汇川技术	4,700,276.00	32.21
12	002415	海康威视	4,392,748.00	30.10
13	000063	中兴通讯	4,147,048.00	28.42
14	002714	牧原股份	4,011,941.00	27.49
15	000568	泸州老窖	3,806,496.00	26.08
16	300498	温氏股份	3,731,357.50	25.57
17	000001	平安银行	3,622,186.00	24.82
18	002352	顺丰控股	3,581,931.00	24.54
19	300274	阳光电源	3,434,559.80	23.53
20	002230	科大讯飞	3,221,395.00	22.07

21	002142	宁波银行	3,167,369.00	21.70
22	000338	潍柴动力	3,070,879.00	21.04
23	300033	同花顺	3,067,062.24	21.02
24	000100	TCL 科技	2,846,516.00	19.50
25	000425	徐工机械	2,828,993.00	19.38
26	300308	中际旭创	2,765,318.00	18.95
27	002027	分众传媒	2,738,003.00	18.76
28	000792	盐湖股份	2,371,856.00	16.25
29	300015	爱尔眼科	2,181,888.00	14.95
30	002050	三花智控	2,051,998.00	14.06
31	000625	长安汽车	2,043,269.00	14.00
32	300014	亿纬锂能	2,021,653.00	13.85
33	002179	中航光电	2,008,896.00	13.76
34	002241	歌尔股份	1,968,176.00	13.49
35	000977	浪潮信息	1,914,184.00	13.12
36	300502	新易盛	1,882,023.00	12.90
37	000002	万 科A	1,853,946.00	12.70
38	002311	海大集团	1,837,065.00	12.59
39	000938	紫光股份	1,812,398.00	12.42
40	002304	洋河股份	1,776,384.00	12.17
41	002049	紫光国微	1,759,009.00	12.05
42	300408	三环集团	1,743,474.00	11.95
43	002028	思源电气	1,727,895.00	11.84
44	000776	广发证券	1,687,998.00	11.57
45	000538	云南白药	1,663,598.00	11.40
46	002422	科伦药业	1,629,708.00	11.17
47	000166	申万宏源	1,624,154.00	11.13
48	300433	蓝思科技	1,481,632.00	10.15
49	002463	沪电股份	1,464,393.00	10.03
50	002460	赣锋锂业	1,454,639.00	9.97
51	301269	华大九天	1,439,573.00	9.86
52	000975	山金国际	1,385,151.00	9.49
53	000157	中联重科	1,336,154.00	9.16
54	000963	华东医药	1,309,432.00	8.97
55	001979	招商蛇口	1,305,589.00	8.95
56	000895	双汇发展	1,290,143.00	8.84
57	002252	上海莱士	1,280,567.00	8.77
58	002916	深南电路	1,260,688.00	8.64
59	002001	新 和 成	1,240,656.00	8.50
60	002648	卫星化学	1,235,930.00	8.47
61	300661	圣邦股份	1,202,822.00	8.24

62	000768	中航西飞	1,202,104.00	8.24
63	002920	德赛西威	1,176,448.00	8.06
64	000661	长春高新	1,166,969.00	8.00
65	002236	大华股份	1,144,751.00	7.84
66	002466	天齐锂业	1,135,263.00	7.78
67	300122	智飞生物	1,091,925.00	7.48
68	002736	国信证券	1,084,910.00	7.43
69	300418	昆仑万维	1,074,990.00	7.37
70	300347	泰格医药	1,069,847.00	7.33
71	000786	北新建材	1,063,274.00	7.29
72	300782	卓胜微	1,053,000.00	7.22
73	000999	华润三九	1,036,265.00	7.10
74	002601	龙佰集团	1,014,133.00	6.95
75	300896	爱美客	1,006,342.00	6.90
76	000596	古井贡酒	1,000,648.00	6.86
77	003816	中国广核	984,088.00	6.74
78	001965	招商公路	969,377.00	6.64
79	002129	TCL 中环	950,102.00	6.51
80	002493	荣盛石化	940,259.00	6.44
81	002180	纳思达	915,690.00	6.27
82	000876	新希望	888,459.00	6.09
83	300759	康龙化成	835,156.00	5.72
84	002709	天赐材料	815,921.00	5.59
85	300394	天孚通信	809,863.00	5.55
86	300628	亿联网络	800,926.00	5.49
87	000301	东方盛虹	790,716.00	5.42
88	300999	金龙鱼	760,417.00	5.21
89	002938	鹏鼎控股	740,885.00	5.08
90	002459	晶澳科技	736,304.00	5.05
91	300316	晶盛机电	710,766.00	4.87
92	300832	新产业	693,603.00	4.75
93	300413	芒果超媒	686,917.00	4.71
94	000617	中油资本	676,995.00	4.64
95	000983	山西焦煤	669,302.00	4.59
96	300979	华利集团	619,065.00	4.24
97	000708	中信特钢	410,873.00	2.82
98	000877	天山股份	328,151.00	2.25

注：买入金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	300750	宁德时代	1,062,525.00	7.28
2	300896	爱美客	933,527.00	6.40
3	000596	古井贡酒	900,616.00	6.17
4	000568	泸州老窖	644,720.00	4.42
5	000538	云南白药	258,757.00	1.77
6	000977	浪潮信息	212,083.00	1.45
7	002463	沪电股份	162,315.00	1.11
8	002466	天齐锂业	142,431.00	0.98
9	000651	格力电器	137,225.00	0.94
10	002180	纳思达	135,750.00	0.93
11	000333	美的集团	130,209.00	0.89
12	300433	蓝思科技	121,767.00	0.83
13	300782	卓胜微	112,771.00	0.77
14	002352	顺丰控股	98,784.00	0.68
15	000768	中航西飞	97,480.00	0.67
16	002049	紫光国微	94,158.00	0.65
17	300124	汇川技术	90,897.00	0.62
18	002714	牧原股份	84,515.00	0.58
19	002129	TCL 中环	69,245.00	0.47
20	300502	新易盛	68,204.00	0.47

注：卖出金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	244,667,454.18
卖出股票收入（成交）总额	6,882,566.78

注：“买入股票成本（成交）总额”和“卖出股票收入（成交）总额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

#### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

---

## **7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细**

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## **7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细**

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

## **7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细**

注：本基金本报告期末未持有权证。

## **7.10 本基金投资股指期货的投资政策**

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，以降低交易成本，提高投资效率，从而更好地跟踪标的指数。

## **7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**

### **7.11.1 本期国债期货投资政策**

本基金投资国债期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场定性和定量的分析，对国债期货和现货基差、国债期货的流动性、波动水平等指标进行跟踪监控，主要选择流动性好、交易活跃的国债期货合约，以降低交易成本，提高投资效率，从而更好地跟踪标的指数。

### **7.11.2 本期国债期货投资评价**

本基金本报告期末未投资国债期货。

## **7.12 投资组合报告附注**

### **7.12.1 声明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形**

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查，或

---

在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

### 7.12.2 声明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

报告期内本基金投资的前十名股票中没有在备选股票库之外的股票。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	—
2	应收清算款	238.59
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	75,547.80
8	其他	—
9	合计	75,786.39

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中未持有流通受限的股票。

#### 7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	001390	古麒绒材	416.76	0.00	新股限售

### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构					
		机构投资者		个人投资者		—	
		持有份额	占总份额 比例 (%)	持有份额	占总份额 比例 (%)	持有份额	占总份额 比例 (%)
280	48,868.91	5,706,271.00	41.70	7,977,023.00	58.30	—	—

### 8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例 (%)
1	方楚勤	2,014,039.00	14.72
2	华泰证券股份有限公司	1,777,820.00	12.99
3	中信证券股份有限公司	1,692,207.00	12.37
4	广发证券股份有限公司	1,214,632.00	8.88
5	浙商证券股份有限公司	1,021,467.00	7.47
6	李军卫	300,068.00	2.19
7	江会	258,029.00	1.89
8	张征	210,012.00	1.53
9	房颖颖	200,003.00	1.46
10	李海湘	199,003.00	1.45

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	—	—

### 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

---

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2025 年 04 月 02 日)基金份额总额	237, 683, 294. 00
基金合同生效日 2025 年 4 月 2 日起至报告期期末基金总申购份额	—
减：基金合同生效日 2025 年 4 月 2 日起至报告期期末基金总赎回份额	224, 000, 000. 00
基金合同生效日 2025 年 4 月 2 日起至报告期期末基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	13, 683, 294. 00

---

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金没有召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内本基金基金管理人无重大人事变动。

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及基金管理人、基金资产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略无改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内基金管理人没有改聘为其审计的会计师事务所。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

#### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，本基金托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 10.7 本期基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易 单元 数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票 成交总额的 比例（%）	佣金	占当期佣金 总量的比例 (%)	
广发证券	4	251,547,302.96	100.00	34,185.77	100.00	—

---

注：我公司对基金交易单元的选择是综合考虑券商的研究能力及其它相关因素后决定的。本基金合同生效日为 2025 年 4 月 2 日，本表中所列券商交易单元均为本报告期新增。

#### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券 成交总额的 比例 (%)	成交金额	占当期债 券回购成 交总额的 比例 (%)	成交金额	占当期权证 成交总额的 比例 (%)
广发证券	—	—	—	—	—	—

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	富国深证 100 交易型开放式指数 证券投资基金基金合同生效公告	规定披露媒介	2025 年 04 月 03 日
2	富国基金管理有限公司关于富国 深证 100 交易型开放式指数证券 投资基金投资关联方证券的公告	规定披露媒介	2025 年 04 月 07 日
3	富国深证 100 交易型开放式指数 证券投资基金开放申购、赎回业务 的公告	规定披露媒介	2025 年 04 月 09 日
4	富国深证 100 交易型开放式指数 证券投资基金上市交易公告书	规定披露媒介	2025 年 04 月 09 日
5	关于富国深证 100 交易型开放式 指数证券投资基金上市交易提示 性公告	规定披露媒介	2025 年 04 月 14 日

---

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2025-04-28 至 2025-04-29	—	22,818, 624.00	21,603 ,992.0 0	1,214,632.0 0	8.88%
产品特有风险							
本基金于报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情形，本基金管理人已经采取措施，审慎确认大额申购与大额赎回，防控产品流动性风险并公平对待投资者。本基金管理人提请投资者注意因单一投资者持有基金份额集中导致的产品流动性风险、大额赎回风险以及净值波动风险等特有风险。							

---

## § 12 备查文件目录

备查文件名称	备查文件存放地点	备查文件查阅方式
1、中国证监会批准设立富国深证 100 交易型开放式指数证券投资基金的文件 2、富国深证 100 交易型开放式指数证券投资基金基金合同 3、富国深证 100 交易型开放式指数证券投资基金托管协议 4、中国证监会批准设立富国基金管理有限公司的文件 5、富国深证 100 交易型开放式指数证券投资基金财务报表及报表附注 6、报告期内在指定报刊上披露的各项公告	中国(上海)自由贸易试验区世纪大道 1196 号世纪汇办公楼二座 27-30 层	投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人富国基金管理有限公司。咨询电话：95105686、4008880688（全国统一，免长途话费）公司网址： <a href="http://www.fullgoal.com.cn">http://www.fullgoal.com.cn</a> 。